

## 南方保本混合型证券投资基金

## 2013第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:南方基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:2013年10月24日  
§1 重要提示  
基金管理人的董事会及监事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告财务资料未经审计。  
本基金自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	南方保本基金
交易代码	202312
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年7月21日
报告期末基金份额总额	2,973,525,317.94份
投资目标	本基金属股票型基金,以投资组合保险机制进行资产配置,在确保保本的前提下追求基金资产的绝对增值。
投资策略	本基金采用绝对回报策略,即投资组合在任何情况下都保持一定的资产配置比例,并以此为基准,通过资产配置、择时操作、个股选择等策略,在确保保本的前提下追求基金资产的绝对增值。
业绩比较基准	本基金采用绝对回报策略(Constant-Proportion Portfolio Insurance,CPI)来实现保本和增值的目標。
风险收益特征	本基金属保本基金,是证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

注:本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合,简称“南方保本”。

## §3 主要财务指标和净值表现

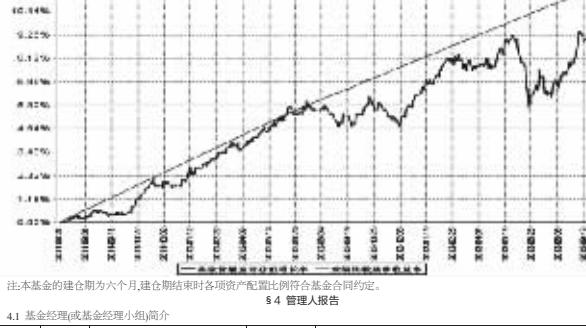
报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)		单位:人民币元
1.本期已实现收益	16,848,635.06	
2.本期利润	79,749,564.40	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0257	
4.期末基金份额净值	3,208,364,594.21	
5.期末基金份额总额	1,079	

注:本期来实现收益扣除非期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益扣除相关费用后的余额)本期利润为本期已实现收益加上本期的公允价值变动收益。

2.本基金业绩比较指标不包括任何认购或交易费用。

序号	报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)	阶段	净值增长①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
1	16,848,635.06		0.0257	0.0196	1.39%	0.18%		

## §3.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金的建仓期为六个月,建仓后即进入正常运作。

## §4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明	
				①	②
孙鲁闽	本基金基金经理	2010年12月14日	-	10	南开大学理学和经济学双学士,澳大利亚新南威尔士大学金融学硕士,具有基金从业资格。曾任职于厦门国际银行分行,2002年1月加入南方基金管理有限公司,历任基金研究部研究员、基金经理助理、基金经理,2007年12月至2010年10月,担任南方保本基金基金经理和南方金元货币基金经理。2010年12月至今,担任本基金基金经理。

注:对本基金的基金经理,其任职日期为基金管理人决定确定的日期,对此后的非基金经理,其任职日期为基金管理人决定确定的日期,其任职日期为基金管理人决定确定的日期,对此后的基金经理,其任职日期为基金管理人决定确定的日期。

4.1 基金经理/基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
孙鲁闽	本基金基金经理	2010年12月14日	-	10

注:本基金的基金经理,其任职日期为基金管理人决定确定的日期,对此后的基金经理,其任职日期为基金管理人决定确定的日期。

4.2 管理人对报告期内基金运作的总体评价

本基金报告期内基金管理人的所有投资组合参与的交易所公开竞价项目对反向交易交款当中的平均差价为-0.0001元,最高为-0.0001元,最低为-0.0001元。

4.3 报告期内基金运作指标评价分析

4.3.1 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.2 常规交易的项目说明

本基金报告期内基金管理人的所有投资组合参与的交易所公开竞价项目对反向交易交款当中的平均差价为-0.0001元,最高为-0.0001元,最低为-0.0001元。

4.3.3 报告期内基金运作指标评价分析

4.3.4 报告期内基金的经营风险

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.5 报告期内基金的经营业绩

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.6 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.7 报告期内基金的经营指标

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.8 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.9 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.10 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.11 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.12 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.13 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.14 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.15 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.16 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.17 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.18 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.19 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.20 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.21 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.22 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.23 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.24 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.25 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.26 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.27 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.28 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.29 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.30 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.31 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.32 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.33 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易行为进行实时监控和分析。

4.3.34 报告期内基金的经营情况

本报告期,本基金管理人严格执行《证券投资基金公开公平交易制度指导意见》,完善公平交易制度及流程,通过系统和人工等各种方式对各交易环节实行交易行为监控,对异常交易